

《資金需給》

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想	5日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	300	0
財政		▲ 6,300	3,500	2,000
資金過不足		▲ 5,300	3,800	2,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		68,307		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		4,800		11,800
CP等買入				
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470		▲ 100	▲ 100	9,000
被災地支援				▲ 7,400
3,244				
社債等買入				
ETF買入		100	200	
国債補充供給				
小計		4,800	100	13,400
当預増減		▲ 500	3,900	15,400

当座預金残高	2,090,500	6/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,912,700		9,600
積み終了先	1,607,800	6/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,607,300	積数	7,600
非準預先残高	177,800	1日平均	600
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,012,300		
準備預金進捗率	99.62% (実績)	61.29% (日数)	

6/2のマネタリーベース		3,032,600	
6/2コール 合計	200,882 無担	70,297 有担	130,585
コール前日増減 計	5,254 無担	4,032 有担	1,222

6/3の加重平均レート(速報)				6/2の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.055 ~ 0.080 (0.074)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~ 0.125 (0.075)			0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.065 ~ 0.120 (0.078)				T/N		0.066 ~ 0.130 (0.083)		
				S/N		0.125 (0.125)		
0.064 ~ 0.130 (0.095)				1W		0.118 ~ 0.200 (0.159)		
0.118 (0.118)				2W		0.118 ~ 0.340 (0.149)		
				3W		0.118 (0.118)		
		0.08-0.13	-	1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.004	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	1,066億円	6/3 ~ 6/4 (1日間) 応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	3,750億円	6/5 応札	10,746億円	落札	3,750億円	按分利回り較差 0.004%	88.4%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	6/5 応札	12,599億円	落札	4,003億円	按分利回り較差 0.011%	74.1%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	4,000億円	6/5 応札	10,389億円	落札	4,007億円	按分利回り較差 0.028%	8.2%	平均利回り較差	0.033%
交付税特会	1兆500億円	6/11~12/11 応札	3兆6,800億円	落札	1兆500億円	0.079% 按分75.0000%	平均0.074%		
ETF買入	370億円	約定日	6/3						

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入

6/4の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,094,400	前日比	3,900
O/N	0.06~0.075	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.07%近辺での出合いが中心になると予想される。

3日のインターバンク市場動向
午前8時発表の準備預金残高見込みは、161兆1,000億円(当座預金残高見込みは209兆円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.072%、大手行からは0.069~0.07%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.073~0.075%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後は調達レートがやや低下し、0.07%台前半での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

3日のオープン市場動向
現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、動意に乏しい閑散とした地合いが継続しており、3Mで▲0.004%の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は、5・10日発行にあたり、償還・発行規模ともに1,300億円弱と若干膨らんだ。ノンバンク業態からの大型発行案件も実施された。発行レートは、月内償還物に対する荷もたれ感からやや上昇した。

4日の材料
*黒田日銀総裁、2015年国際コンファランス「金融政策:効果と実践」にて講演
*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、6/8発行)
*30年利付国債入札(8,000億円、6/22発行)

《コール5月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.06945%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06928%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.465	0.055	日経平均株価(終値)	20,473.51	▲ 69.68	為替(9時)	124.05-06
						為替(5時)	124.15-17

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	5/27	5/28	5/29	6/1	6/2	6/3
日銀当預残	2,135,700	2,119,800	2,130,200	2,111,900	2,091,000	2,090,500
準備預金残	1,942,400	1,927,500	1,944,600	1,931,900	1,915,600	1,912,700
レート	0.074%	0.071%	0.073%	0.073%	0.075%	0.074%
月中平均	0.06900%	0.06907%	0.06945%	0.07300%	0.07400%	0.07400%